
建信全球机遇股票型证券投资基金

2011 年半年度报告

2011 年 6 月 30 日

基金管理人：建信基金管理有限责任公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一一年八月二十四日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2011 年 8 月 19 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
1.1 重要提示.....	1
1.2 目录.....	2
§2 基金简介.....	4
2.1 基金基本情况.....	4
2.2 基金产品说明.....	4
2.3 基金管理人和基金托管人.....	4
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人.....	4
2.5 信息披露方式.....	5
2.6 其他相关资料.....	5
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现.....	6
§4 管理人报告.....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介.....	9
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	31
7.1 期末基金资产组合情况.....	31
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布.....	31
7.3 期末按行业分类的权益投资组合.....	32
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细.....	32
7.5 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	48
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细.....	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	48
7.11 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49

10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	52
§11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	建信全球机遇股票型证券投资基金
基金简称	建信全球机遇股票 (QDII)
基金主代码	539001
交易代码	539001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年9月14日
基金管理人	建信基金管理有限责任公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	363,573,003.78份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过全球化的资产配置和组合管理，在分散和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。
投资策略	本基金采取“自上而下”的资产配置与“自下而上”的证券选择相结合、定量研究与定性研究相结合、组合构建与风险控制相结合的投资策略进行投资组合的构建。
业绩比较基准	标准普尔全球BMI市场指数总收益率 (S&P Global BMI) × 70% + 标准普尔BMI中国 (除A、B股) 指数总收益率 (S&P BMI China ex-A-B-Shares) × 30%
风险收益特征	本基金是全球股票型基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		建信基金管理有限责任公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	路彩营	赵会军
	联系电话	010-66228888	010—66105799
	电子邮箱	xinxipilu@ccbfund.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-81-95533 010-66228000	95588
传真		010-66228001	010—66105798
注册地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		江先周	姜建清

2.4 境外投资顾问和境外资产托管人

项目	境外投资顾问	境外资产托管人

名称	英文	Principal Global Investors. LLC.	Brown Brothers Harriman & Co.
	中文	信安环球投资有限公司	布朗兄弟哈里曼银行
注册地址		801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway New York
办公地址		801 Grand Avenue, Des Moines	140 Broadway New York
邮政编码		IA 50392-0490	NY10005

2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ccbfund.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	建信基金管理有限责任公司	北京市西城区金融大街 7 号英蓝国际金融中心 16 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-302,256.86
本期利润	3,022,809.00
加权平均基金份额本期利润	0.0066
本期加权平均净值利润率	0.67%
本期基金份额净值增长率	-0.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
期末可供分配利润	-7,673,246.43
期末可供分配基金份额利润	-0.0211
期末基金资产净值	355,899,757.35
期末基金份额净值	0.979
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2011 年 6 月 30 日）
基金份额累计净值增长率	-2.10%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、汇兑损益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

4、本基金 2010 年 9 月 14 日成立，合同生效当期未满 6 个月。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-2.20%	0.75%	-2.28%	0.90%	0.08%	-0.15%
过去三个月	-2.59%	0.79%	-0.51%	0.84%	-2.08%	-0.05%
过去六个月	-0.51%	0.81%	3.90%	0.84%	-4.41%	-0.03%
成立至今	-2.10%	0.73%	14.65%	0.83%	-16.75%	-0.10%

注：1、本基金的业绩比较基准为：标准普尔全球 BMI 市场指数总收益率（S&P Global BMI）×70% + 标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数总收益率（S&P BMI China ex-A-B-Shares）×30%。

标准普尔全球市场指数（S&P Global BMI）是市场中首只采用自由流通市值进行加权的全市场指数。该指数覆盖全球 47 个市场的 12,000 多家上市公司，其中包括 26 个发达市场和 21 个发展中市场；涵盖全球上市股票约 97% 的市值，在国际上被广泛采用为有关投资产品的业绩基准。

标准普尔 BMI 中国（除 A、B 股）指数（S&P BMI China ex-A-B-Shares）是由标准普尔指数公司于 2007 年 11 月 15 日推出的标准普尔 QDII 系列指数之一，旨在为中国境内合格机构投资者（QDII）在海外资本市场进行投资提供广泛的市场比较基准和投资方案。该指数反映在香港证券市场、美国证券市场、新加坡证券市场、日本证券市场上市的以外币计价的的中国公司股票价格走势。

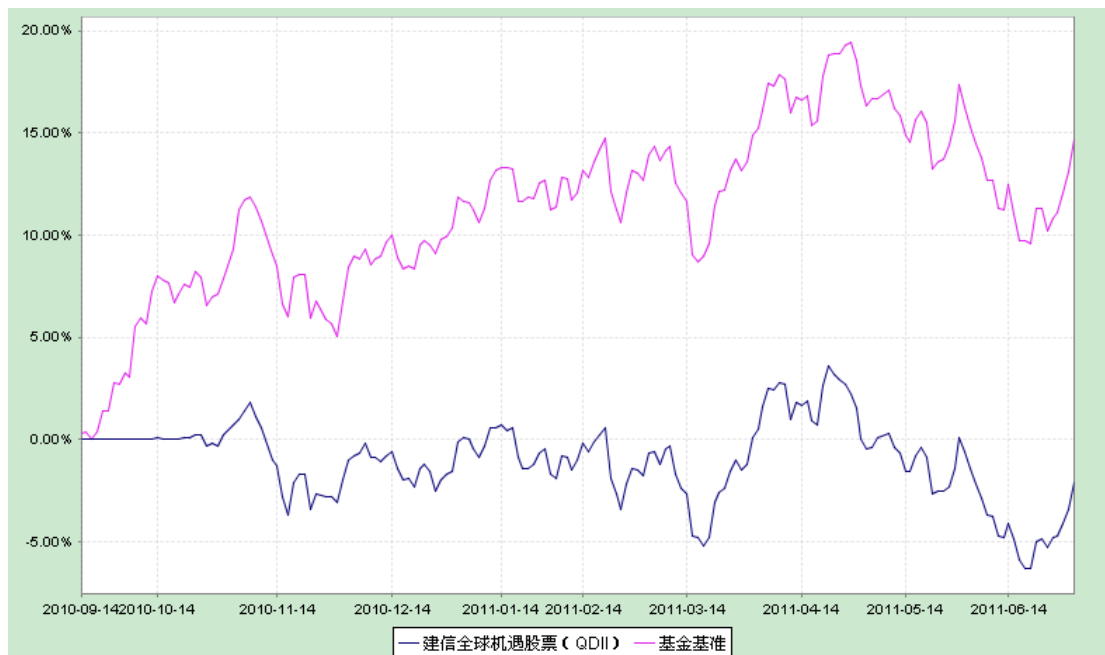
2、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

建信全球机遇股票型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 9 月 14 日至 2011 年 6 月 30 日）



注： 1、本基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，成立未满一年。

2、本基金为股票型基金，投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

本基金投资于境外上市的中国公司股票的股票投资组合称为“海外中国组合”，投资于其他上市公司股票的股票投资组合称为“全球（中国除外）组合”。其中，境外上市的中国公司是指在香港、美国、英国、新加坡等地上市的公司，这些公司注册于中国大陆境内，或者虽注册于中国大陆境外，但其主要控股股东或主要业务收入源自中国大陆。

海外中国组合占本基金股票投资的目标比例为 30%（比例范围 0%-60%）；全球（中国除外）组合占本基金股票投资的目标比例为 70%（比例范围 40%-100%）。

3、同期业绩比较基准以美元计价，不包含人民币汇率变动等因素产生的效应。

4、本报告期，本基金的投资组合比例符合基金合同的要求。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2005]158 号文批准，建信基金管理有限责任公司成立于 2005 年 9 月 19 日，注册资本 2 亿元。目前公司的股东为中国建设银行股份有限公司、信安金融服务公司、中国华电集团资本控股有限公司，其中中国建设银行股份有限公司出资额占注册资本的 65%，信安金融服务公司出资额占注册资本的 25%，中国华电集团资本控股有限公司出资额占注册资本的 10%。

公司下设综合管理部、投资管理部、专户投资部、海外投资部、交易部、研究部、创新发展部、市场营销部、专户理财部、市场推广部、人力资源管理部、基金运营部、信息技术部、风险管理部和监察稽核部，以及深圳、成都、上海、北京四家分公司。自成立以来，公司秉持“诚信、专业、规范、创新”的核心价值观，恪守“持有人利益重于泰山”的原则，以“建设财富生活”为崇高使命，坚持规范运作，致力成为“最可信赖、持续领先的资产管理公司”。

截至 2011 年 6 月 30 日，公司旗下有建信恒久价值股票型证券投资基金、建信货币市场基金、建信优选成长股票型证券投资基金、建信优化配置混合型证券投资基金、建信稳定增利债券型证券投资基金、建信核心精选股票型证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、建信沪深 300 指数证券投资基金(LOF)、上证社会责任交易型开放式证券投资指数基金及其联接基金、建信全球机遇股票型证券投资基金、建信内生动力股票型证券投资基金、建信保本混合型证券投资基金、建信双利策略主题分级股票型证券投资基金、建信新兴市场优选股票型证券投资基金 15 只开放式基金和建信优势动力股票型证券投资基金、建信信用增强债券型证券投资基金 2 只封闭式基金，管理的基金资产规模共计为 433.13 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
赵英楷先生	海外投资部 总监，本基金 基金经理	2011-04-20	-	15	美国哥伦比亚大学商学院 MBA，曾任美国美林证券公司研究员、高盛证券公司研究员、美林证券公司投资组合策略分析师、美国阿罗亚投资公司基金经理；2010 年 3 月加入建信基金管理有限责任公司，历任海外投资部执行总监（主持工作）、总监。2011 年 6 月 21 日起任建信新兴市场优选股票型证券投资基金基金经理。
高茜女士	海外投资部 副总监，本基 金基金经理	2010-09-14	-	13	注册金融分析师（CFA），获清华大学建筑学学士学位及美

					<p>国俄亥俄州克利夫兰州立大学城市研究学硕士学位，先后任职于美国美林证券公司、美国基石房地产投资管理公司、英国阿特金斯顾问（北京）有限公司、美国信安金融集团等公司，担任证券研究员、研究总监、首席投资顾问、助理基金经理、投资风险顾问等职。高茜于 2007 年 12 月加入我公司，现任海外投资部副总监。</p>
--	--	--	--	--	---

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Mustafa Sagun	信安环球投资有限公司首席投资官 (CIO)	14	<p>南佛罗里达大 MagnaCumLaude 博士，注册金融分析师 (CFA)。1996 年-1997 年，所罗门兄弟有限公司 股权衍生品做市商，担任联系交易室与后台部门的职能；为指数套利、风险套利、可转换债券以及拉美衍生品交易室提供支持。1997 年-2000 年，PNC 金融服务集团 副总裁、数量研究员，向总裁办公室以及管理财提供信息及相关工具以供公司决策。2000 年至今，信安环球投资有限公司首席投资官 (CIO)，担任信安环球投资公司股票投资部首席投资官，负责管理所有国外、国内及全球股票投资组合管理和研究情况；同时，管理资产配置并担任全球股票组合的首席基金经理。</p>

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、基金合同和其他法律法规、部门规章，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益，没有发生违反法律法规的行为。

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4.1 公平交易制度的执行情况

为了公平对待投资人，保护投资人利益，避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为，公司根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司特定客户资产管理业务试点办法》等法律法规和公司内部制度，制定和修订了《公平交易管理办法》、《异常交易管理办法》、《公司防范内幕交易管理办法》、《利益冲突管理办法》等风险管控制度。公司使用的交易系统中设置了公平交易模块，一旦出现不同基金同时买卖同一证券时，系统自动切换至公平交易模块进行操作，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严禁直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本报告期内，本基金管理人不存在与本基金投资风格相似的投资组合。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本报告期，未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.5.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年全球市场前高后平，一季度市场缓步上扬，二季度大幅震荡。上半年行情主要受到四个因素影响：美国经济增长节奏的变换、欧洲债务问题、日本地震及其对全球经济的影响、中国及新兴市场国家的通胀困扰。具体的经济表现是：一季度美国经济延续 2010 年四季度趋势超预期反弹，消费、就业、GDP 增长均好于预期。欧洲在德国带动下，经济复苏良好。虽然经历了日本地震，全球市场在一季度总体上涨。二季度希腊债务问题成为市场焦点，受油价高企及日本地震后全球供应链中断的影响，美国经济数据也开始显现疲软迹象，美国就业

状况、消费均不尽人意，QE2 即将结束带来的不确定性等因素均给投资人带来较大压力，市场呈现大幅震荡行情。

如我们二季报陈述的：从大周期看，全球经济依旧在复苏，而在每次复苏过程中总会有磕磕绊绊。投资人在经济数据持续向好时对经济复苏的力度期望太高，而在经济趋势稍有反复时又突然转向悲观。投资人应该更加关注大趋势：即全球复苏带来的市场上涨的机会。伯南克 6 月中旬对美国经济评论中说：虽然美国经济的复苏速度比美联储预期的要慢，但美国经济增速也保持着适当速度。我们认为未来较长时间内美国及全球经济复苏很可能会延续这一趋势。本基金上半年较好地把握了市场节奏，一季度增加了成熟市场的配置，二季度担心经济走软降低了仓位，6 月下旬加仓并增加了前期超跌股票和周期类股票的配置。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金上半年净值增长率-0.51%，波动率 0.81%，业绩比较基准收益率 3.9%，波动率 0.84%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我们认为全球股票市场有上行空间，但震荡区间也较大。全球经济复苏、发达国家通胀水平总体可控、日本产能全面恢复、股票市场平均估值合理是推动成熟市场上行的主要因素；目前新兴市场紧缩政策进入收尾阶段，估计在未来几个月新兴市场主要国家紧缩政策将得以缓解，政策可能转向促进经济增长、从而带动新兴市场走出上半年的调整格局。未来全球投资人主要顾虑集中在欧洲债务问题、新兴市场主要国家目前通胀水平较高、美国债务僵局以何种方式解决等方面。

下半年全球市场将极大程度地挑战投资管理人的投资能力。我们认为市场会在较大幅度震荡中缓慢上行：上述事件型风险的短期恶化将促使市场下跌，但各国政府随后可能推出的应对方案又会推动市场上涨。从基本面看，我们对美国、欧洲等发达市场在第二季度放缓后的增长前景仍然审慎乐观，但同时任何明显的经济增长放缓都会引发美联储类似 QE3 的货币宽松政策的出台，进而推动市场上行。未来投资的关键是有效把握市场整体节奏，通过仓位、行业板块调整以及个股选择取得超额收益。投资人需要理解的是全球经济在经历了 2008 年的巨大冲击后，需要解决的问题较多，时间较长，但复苏的步伐是确定的，未来较长时间市场保持上升趋势是大概率事件，所以投资人应该在风险来临时保持稳定心

态，积极参与市场，获取潜在的长期投资收益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，本管理人根据中国证监会[2008]38 号文《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定，继续加强和完善对基金估值的内部控制程序。

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策；对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督；对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更。估值委员会由公司分管估值业务的副总经理、督察长、投资总监、研究总监、风险管理总监、运营总监及监察稽核总监组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、数量研究员、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成（具体人员由相关部门根据专业胜任能力和相关工作经历进行指定）。估值工作小组负责日常追踪可能对公司旗下基金持有的证券的发行人、所属行业、相关市场等产生影响的各类事件，发现估值问题；提议基金估值调整的相关方案并进行校验；根据需要提出估值政策调整的建议以及提议和校验不用于现有的估值政策的新的投资品种的估值方案，报基金估值委员会审议批准。

基金运营部根据估值委员会的决定进行相关具体的估值调整或处理，并负责与托管行进行估值结果的核对。涉及模型定价的，由估值工作小组向基金运营部提供模型定价的结果，基金运营部业务人员复核后使用。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定，但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。本公司参与估值流程的各方之间不存在任何的重大利益冲突。

本报告期内，公司已与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的国内银行间固定收益品种进行估值。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截止本报告期末本基金可供分配利润为-7,673,246.43 元，根据相关法律法规及本基金合同中关于收益分配条款的规定，本基金本报告期未达到利润分配条件，未进行利润分配。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2011 年上半年，本基金托管人在对建信全球机遇股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2011 年上半年，建信全球机遇股票型证券投资基金的管理人——建信基金管理有限责任公司在建信全球机遇股票型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，建信全球机遇股票型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对建信基金管理有限责任公司编制和披露的建信全球机遇股票型证券投资基金 2011 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2011 年 8 月 19 日

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

报告截止日：2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	29,666,766.72	42,390,401.01
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	301,156,869.58	484,610,982.68
其中：股票投资		301,156,869.58	453,289,110.63
基金投资		-	31,321,872.05
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	27,900,161.85	28,200,162.30
应收证券清算款		774,223.00	-
应收利息	6.4.7.5	48,292.22	20,444.10
应收股利		1,645,348.57	237,971.56
应收申购款		12,835.75	23,628.26
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	1,024,445.30	6,186.40
资产总计		362,228,942.99	555,489,776.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		3,492,229.07	-
应付赎回款		849,469.58	5,608,919.20
应付管理人报酬		519,030.17	856,154.39
应付托管费		100,922.50	166,474.47
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	338.85	1,652.08
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,367,195.47	253,178.35
负债合计		6,329,185.64	6,886,378.49
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	363,573,003.78	557,627,789.53
未分配利润	6.4.7.10	-7,673,246.43	-9,024,391.71
所有者权益合计		355,899,757.35	548,603,397.82
负债和所有者权益总计		362,228,942.99	555,489,776.31

注：1、报告截止日 2011 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.979 元，基金份额总额 363,573,003.78 份。

2、本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.2 利润表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	2010 年 1 月 1 日至 2010 年 6 月 30 日
一、收入		9,917,498.74	-
1.利息收入		248,449.17	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	83,845.56	-
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		164,603.61	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,565,751.92	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-717,820.17	-
基金投资收益	6.4.7.13	1,883,777.17	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	19,962.47	-
股利收益	6.4.7.16	5,379,832.45	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,325,065.86	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-468,228.88	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	246,460.67	-
减：二、费用		6,894,689.74	-
1.管理人报酬		4,052,598.85	-
2.托管费		788,005.30	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	6.4.7.19	1,743,673.21	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		310,412.38	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,022,809.00	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,022,809.00	-

注：本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：建信全球机遇股票型证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	557,627,789.53	-9,024,391.71	548,603,397.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	3,022,809.00	3,022,809.00

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-194,054,785.75	-1,671,663.72	-195,726,449.47
其中: 1.基金申购款	1,452,260.98	-18,947.40	1,433,313.58
2.基金赎回款	-195,507,046.73	-1,652,716.32	-197,159,763.05
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	363,573,003.78	-7,673,246.43	355,899,757.35
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	-	-	-

注: 本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效, 合同生效当期未满 6 个月。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人: 孙志晨, 主管会计工作负责人: 何斌, 会计机构负责人: 秦绪华

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

建信全球机遇股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]第 982 号《关于核准建信全球机遇股票型证券投资基金募集的批复》核准, 由建信基金管理有限责任公司依

照《中华人民共和国证券投资基金法》、《合格境内机构投资者境外证券投资管理试行办法》和《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金募集期限自 2010 年 8 月 11 日起至 2010 年 9 月 10 日止。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 681,859,858.00 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 232 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》于 2010 年 9 月 14 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 681,944,805.65 份基金份额，其中认购资金利息折合 84,947.65 份基金份额。本基金的基金管理人为建信基金管理有限责任公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，境外资产托管人为布朗兄弟哈里曼银行（Brown Brothers Harriman & Co.），境外投资顾问为信安环球投资有限公司(Principal Global Investors .LLC.)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为全球证券市场中具有良好流动性的金融工具，包括股票和其他权益类证券、现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具。其中，股票及其他权益类证券包括中国证监会允许投资的普通股、优先股、存托凭证、公募股票基金等。现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具包括银行存款、可转让存单、回购协议、短期政府债券等货币市场工具，中长期政府债券、公司债券、可转换债券、债券基金、货币市场基金等及经中国证监会认可的国际金融组织发行的证券，中国证监会认可的境外交易所上市交易的金融衍生产品等。其中，本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于 60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为标准普尔全球 BMI 市场指数总收益率(S&P Global BMI)×70% + 标准普尔 BMI 中国(除 A、B 股)指数总收益率(S&P BMI China ex-A-B-Shares)×30%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日颁布的《企业会计准则—基本准则》和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、

中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》和中国证监会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期内无重大会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他境内外相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

- (1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。
- (2) 基金取得的源自境外的差价收入，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂免征营业税和企业所得税。
- (3) 基金取得的源自境外的股利收益，其涉及的境外所得税税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
活期存款	29,666,766.72
定期存款	-
其他存款	-
合计	29,666,766.72

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	295,591,721.44	301,156,869.58	5,565,148.14
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	债券合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	295,591,721.44	301,156,869.58	5,565,148.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入返售证券	27,900,161.85	-
交易所买入返售证券	-	-
合计	27,900,161.85	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购余额，故未存在因此取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日
应收活期存款利息	2,812.73
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	45,479.49
应收申购款利息	-
其他	-
合计	48,292.22

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	-
应收未起息外汇交易款	1,024,445.30
合计	1,024,445.30

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	338.85
合计	338.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,201.41
预提费用	339,476.72
应付未起息外汇交易款	1,024,517.34
合计	1,367,195.47

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2011 年 1 月 1 日至 2011 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	557,627,789.53	557,627,789.53
本期申购	1,452,260.98	1,452,260.98
本期赎回（以“-”号填列）	-195,507,046.73	-195,507,046.73
本期末	363,573,003.78	363,573,003.78

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-10,944,227.95	1,919,836.24	-9,024,391.71
本期利润	-302,256.86	3,325,065.86	3,022,809.00
本期基金份额交易产生的变动数	4,255,476.59	-5,927,140.31	-1,671,663.72
其中：基金申购款	-29,832.72	10,885.32	-18,947.40
基金赎回款	4,285,309.31	-5,938,025.63	-1,652,716.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,991,008.22	-682,238.21	-7,673,246.43

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
活期存款利息收入	83,845.56
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	83,845.56

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出股票成交总额	655,462,450.45
减：卖出股票成本总额	656,180,270.62
买卖股票差价收入	-717,820.17

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	125,893,543.31
减：卖出/赎回基金成本总额	124,009,766.14
基金投资收益	1,883,777.17

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内未发生卖出债券、债转股及到期兑付等交易。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
卖出权证成交金额	19,962.47
减：卖出权证成本总额	-
买卖权证差价收入	19,962.47

注：本基金本报告期的权证投资为获赠权证。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,379,832.45
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,379,832.45

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
1.交易性金融资产	3,325,065.86
——股票投资	3,325,065.86
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
合计	3,325,065.86

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
基金赎回费收入	246,460.67
合计	246,460.67

注：本基金赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
交易所市场交易费用	1,743,673.21
银行间市场交易费用	-
合计	1,743,673.21

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日
审计费用	37,687.81
信息披露费	148,767.25
税务咨询费	99,178.58
其他	24,778.74
合计	310,412.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至报表批准报出日，本基金未存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至报表批准报出日，本基金未存在资产负债表日后发生的利润分配、基金拆分、

基金转型等非调整事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

经建信基金管理有限责任公司(以下简称"公司")2010年度第二次临时股东会审议通过,并于2011年5月4日中国证监会证监许可[2011]648号文批准,本公司原股东中国华电集团公司将所持有的建信基金管理有限责任公司10%的股权转让给中国华电集团资本控股有限公司。该事项已于2011年6月9日在中国证券报、上海证券报、证券时报及我公司网站公开披露。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
建信基金管理有限责任公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金托管人、基金代销机构
布朗兄弟哈里曼银行(Brown Brothers Harriman & Co.)	境外资产托管人

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。本基金基金合同自2010年9月14日生效,合同生效当期未满6个月,无上年可比期间。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,052,598.85	-
其中:支付销售机构的客户 维护费	2,150,761.62	-

注:1、支付基金管理人建信基金管理有限责任公司的管理人报酬按按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值1.8%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的管理人报酬,逐日累计至每月月底,按月支付给基金管理人建信基金管理有限责任公司。其计算公式为:

日管理人报酬=估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 1.8%/ 当

年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

3、本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年6月30日	2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	788,005.30	-

注：1、支付基金托管人中国工商银行的托管费按估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 0.35%的年费率计提自上一估值日(不含上一估值日)至估值日(含估值日)的托管费，逐日累计至每月月底，按月支付给基金托管人中国工商银行。其计算公式为：

日托管费 = 估值日尚未计提当日管理人报酬及托管费的基金资产净值 X 0.35% / 当年天数。

2、本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末通过关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2011年1月1日至2011年6月30日		2010年1月1日至2010年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	15,922,998.82	80,394.19	-	-
布朗兄弟哈里	13,743,767.90	3,451.37	-	-

曼银行				
-----	--	--	--	--

注：1、本基金的银行存款分别由基金托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行保管，按适用利率计息。

2、本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末通过关联方购买其承销的证券。本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，合同生效当期未满 6 个月。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末未发生其他需要说明的关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2011 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌而流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截止本报告期末，本基金没有因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截止本报告期末，本基金没有因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为全球股票型证券投资基金，其风险和收益高于货币基金、债券基金和混合型基金，属于较高风险、较高收益的投资品种。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、基金投资及权证投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过全球化的资产配置和组合管理，在分散

和控制投资风险的同时追求基金资产长期增值。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设,在董事会下设立审计与风险控制委员会,根据公司总体战略负责拟订公司风险战略和风险管理政策,并对其实施情况及效果进行监督和评价,指导公司的风险管理和内控制度建设;对公司经营管理和基金业务运作的合法性、合规性和风险状况进行检查和评估;监督公司的财务状况,审计公司的财务报表,评估公司的财务表现,保证公司的财务运作符合法律的要求和通行的会计标准;在管理层层面设立风险管理委员会,主要负责制定公司经营管理中的风险控制政策,组织制定公司经营管理中的内部风险控制制度;对公司管理层在投资、市场、信用、操作等方面的风险控制情况进行监督,管理层应如实向风险管理委员会汇报有关风险控制情况;以及对公司经营管理过程中的风险状况进行定期或不定期评估。在业务操作层面,风险管理部负责公司旗下基金及其它受托资产投资中的风险识别、评估和控制;监察稽核部承担其他风险的管理职责,负责在各业务部门一线风险控制的基础上实施风险再控制。

本基金的基金管理人建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行和境外资产托管人布朗兄弟哈里曼银行,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与境外

当地授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券在证券交易所上市，均能以合理价格适时变现。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动

的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2011 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资（2010 年 12 月 31 日：同），且持有的银行存款均为活期存款，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2011年6月30日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
银行存款	25,040,947.05	3,642,132.49	67,184.60	28,750,264.14
交易性金融资产	101,447,748.71	129,894,591.87	69,814,529.00	301,156,869.58
应收股利	163,493.26	1,292,271.96	189,583.35	1,645,348.57
资产合计	126,652,189.02	134,828,996.32	70,071,296.95	331,552,482.29
应付未起息 外汇	183,112.11	-	841,405.23	1,024,517.34
应付证券清算款	1,034,679.43	2,274,284.85	183,264.79	3,492,229.07
负债合计	1,217,791.54	2,274,284.85	1,024,670.02	4,516,746.41
资产负债表 外汇风险敞 口净额	125,434,397.48	132,554,711.47	69,046,626.93	327,035,735.88

项目	上年度末 2010年12月31日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
银行存款	13,711,285.19	19,283,854.68	6,237.66	33,001,377.53
交易性金融资产	141,665,391.82	216,878,698.56	126,066,892.30	484,610,982.68
应收股利	111,918.20	30,378.20	95,674.72	237,971.12
资产合计	155,488,595.21	236,192,931.44	126,168,804.68	517,850,331.33
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	155,488,595.21	236,192,931.44	126,168,804.68	517,850,331.33

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2011年6月30日）	上年度末（2010年12月31日）
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约17,730,967.37	减少约27,430,169.89
	所有外币相对人民币升值5%	增加约17,730,967.37	增加约27,430,169.89

注：本基金基金合同自 2010 年 9 月 14 日生效，至本报告截止日 2011 年 6 月 30 日，本基金成立未满一年。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票、基金和衍生工具，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金投资组合中股票及其他权益类证券市值占基金资产的比例不低于

60%；现金、债券及中国证监会允许投资的其他金融工具市值占基金资产的比例不高于 40%，其中现金和到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2011 年 6 月 30 日		上年度末 2010 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	301,156,869.58	84.62	453,289,110.63	82.63
交易性金融资产-基金投资			31,321,872.05	5.71
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	301,156,869.58	84.62	484,610,982.68	88.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2011 年 6 月 30 日	上年度末 2010 年 12 月 31 日
	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	增加约18,215,022.78	-
	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	减少约18,215,022.78	-

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、

除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2011 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 301,156,869.58 元，无属于第二层级和第三层级的余额。于本期内，本基金持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	301,156,869.58	83.14
	其中：普通股	278,099,541.97	76.77
	存托凭证	23,057,327.61	6.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	27,900,161.85	7.70
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	29,666,766.72	8.19
8	其他各项资产	3,505,144.84	0.97
9	合计	362,228,942.99	100.00

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
中国香港	129,894,591.87	36.50
美国	98,512,826.28	27.68
英国	19,207,828.08	5.40
日本	13,515,801.98	3.80
德国	11,849,884.67	3.33
法国	7,524,111.41	2.11
加拿大	5,257,041.95	1.48
澳大利亚	4,514,737.98	1.27

瑞典	3,439,284.14	0.97
意大利	3,392,399.70	0.95
瑞士	3,084,752.35	0.87
荷兰	963,609.17	0.27
合计	301,156,869.58	84.62

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
金融	71,621,726.80	20.12
信息技术	40,406,223.43	11.35
能源	49,600,400.92	13.94
非必需消费品	25,393,200.06	7.13
工业	29,045,365.73	8.16
材料	23,942,468.35	6.73
电信服务	19,123,355.80	5.37
必需消费品	21,105,357.73	5.93
保健	13,277,576.48	3.73
公用事业	7,641,194.20	2.15
合计	301,156,869.50	84.62

注：以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	BANK OF CHINA LTD	中国银行	CNE1000001Z5	香港证券交易所	中国香港	3,360,300	10,591,127.31	2.98
2	CHINA MOBILE LTD	中国移动	HK0941009539	香港证券交易所	中国香港	152,500	9,131,187.61	2.57
3	CNOOC LTD	中国海洋石油	HK0883013259	香港证券交易所	中国香港	535,000	8,079,687.29	2.27
4	BAIDU INC/CHINA	百度股份	US0567521085	纳斯达克交易所	美国	8,800	7,980,414.87	2.24
5	PETROCHINA CO LTD	中国石油天然气	CNE1000003W8	香港证券	中国	724,000	6,851,816.99	1.93

				交易所	香港			
6	TENCENT HOLDINGS LTD	腾讯控股	KYG875721485	香港证券交易所	中国香港	29,000	5,093,506.18	1.43
7	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	中国农业银行	CNE100000Q43	香港证券交易所	中国香港	1,489,000	5,064,574.13	1.42
8	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	招商银行	CNE1000002M1	香港证券交易所	中国香港	276,000	4,315,109.86	1.21
9	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	中国平安保险	CNE1000003X6	香港证券交易所	中国香港	63,000	4,209,702.03	1.18
10	YANZHOU COAL MINING CO LTD	兖州煤业	CNE1000004Q8	香港证券交易所	中国香港	166,000	4,086,248.03	1.15
11	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	中国神华能源	CNE1000002R0	香港证券交易所	中国香港	127,000	3,918,343.96	1.10
12	CHINA TELECOM CORP LTD	中国电信	CNE1000002V2	香港证券交易所	中国香港	848,000	3,554,277.37	1.00
13	TOTAL SA	道达尔公司	FR0000120271	巴黎证券交易所	法国	9,200	3,434,586.88	0.97
14	CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD	民生银行	CNE100000HF9	香港证券交易所	中国香港	552,000	3,291,418.90	0.92
15	CHEVRON CORP	雪佛龙	US1667641005	纽约证券交易所	美国	4,900	3,261,142.85	0.92
16	ROYAL DUTCH SHELL PLC	荷兰皇家壳牌石油	GB00B03MM408	伦敦证券交易所	英国	14,000	3,237,708.15	0.91
17	ORACLE CORP	甲骨文公司	US68389X1054	纳斯达克交易所	美国	15,100	3,216,003.43	0.90

18	EXXON MOBIL CORP	艾克索美孚	US30231G1022	纽约证券交易所	美国	6,100	3,212,618.80	0.90
19	SIEMENS AG	西门子	DE0007236101	德国证券交易所	德国	3,600	3,191,420.36	0.90
20	BASF SE	巴斯夫	DE000BASF111	德国证券交易所	德国	5,000	3,162,681.47	0.89
21	WAL-MART STORES INC	沃尔玛百货	US9311421039	纽约证券交易所	美国	8,800	3,026,327.31	0.85
22	ACCENTURE PLC	-	IE00B4BNMY34	纽约证券交易所	美国	7,400	2,893,504.19	0.81
23	GENERAL DYNAMICS CORP	通用动力公司	US3695501086	纽约证券交易所	美国	5,900	2,845,355.48	0.80
24	ASTRAZENECA PLC	阿斯特捷利康	GB0009895292	伦敦证券交易所	英国	8,700	2,811,739.90	0.79
25	FREEMPORT-MCMORAN COPPER & GOLD	自由港麦克莫兰铜金公司	US35671D8570	纽约证券交易所	美国	7,900	2,704,546.41	0.76
26	SAFEWAY INC	喜互惠	US7865142084	纽约证券交易所	美国	18,000	2,722,343.31	0.76
27	ENEL SPA	意大利国家电力公司	IT0003128367	意大利证券交易所	意大利	63,100	2,660,475.54	0.75
28	SHIRE PLC	希尔制药集团	JE00B2QKY057	伦敦证券交易所	英国	13,200	2,669,736.60	0.75
29	BMC SOFTWARE INC	BMC 软件公司	US0559211000	纳斯达克交易所	美国	7,500	2,654,973.95	0.75
30	M&T BANK CORP	M&T 银行集团	US55261F1049	纽约证券	美国	4,700	2,675,132.99	0.75

				交易所				
31	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	中国人寿	CNE1000002L3	香港证券交易所	中国香港	119,000	2,632,409.95	0.74
32	CA INC	CA 国际	US12673P1057	纳斯达克交易所	美国	17,600	2,601,479.71	0.73
33	CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT	中国海外发展	HK0688002218	香港证券交易所	中国香港	186,000	2,580,084.43	0.72
34	REPSOL YPF SA	-	US76026T2050	美国 OTC 市场	美国	11,200	2,519,471.59	0.71
35	ARKEMA SA	阿科玛公司	FR0010313833	巴黎证券交易所	法国	3,700	2,458,840.91	0.69
36	GREAT WALL MOTOR CO LTD	长城汽车	CNE100000338	香港证券交易所	中国香港	232,000	2,469,578.77	0.69
37	MARATHON OIL CORP	马拉松石油	US5658491064	纽约证券交易所	美国	7,200	2,454,652.05	0.69
38	HITACHI LTD	日立制作所有限公司	JP3788600009	东京证券交易所	日本	64,000	2,429,116.10	0.68
39	APPLE INC	苹果计算机	US0378331005	纳斯达克交易所	美国	1,100	2,389,554.21	0.67
40	INTIME DEPARTMENT STORE GROUP	银泰百货商店	KYG492041036	香港证券交易所	中国香港	215,000	2,363,713.53	0.66
41	BT GROUP PLC	英国电信集团	GB0030913577	伦敦证券交易所	英国	111,500	2,336,279.50	0.66
42	FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB	-	US3444191064	纽约证券交易所	美国	5,300	2,280,572.48	0.64
43	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP LTD	中国山水	KYG2116M1015	香港	中	299,000	2,235,402.89	0.63

		水泥集团		证券交易所	国香港			
44	FOCUS MEDIA HOLDING LTD	分众传媒	US34415V1098	纳斯达克交易所	美国	10,900	2,193,807.73	0.62
45	CHINA RESOURCES ENTERPRISE LTD	华润创业	HK0291001490	香港证券交易所	中国香港	82,000	2,168,532.33	0.61
46	GOME ELECTRICAL APPLIANCES HOLDINGS	国美电器	BMG3978C1249	香港证券交易所	中国香港	818,000	2,115,624.65	0.59
47	COMCAST CORP	-	US20030N1019	纳斯达克交易所	美国	12,700	2,082,677.41	0.59
48	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP	中国太平洋保险	CNE1000009Q7	香港证券交易所	中国香港	75,800	2,032,936.68	0.57
49	PICC PROPERTY & CASUALTY CO LT	中国财险	CNE100000593	香港证券交易所	中国香港	184,000	2,025,959.38	0.57
50	CHINA RESOURCES POWER HOLDING	华润电力	HK0836012952	香港证券交易所	中国香港	154,000	1,944,094.71	0.55
51	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	中国石化	CNE1000002Q2	香港证券交易所	中国香港	294,000	1,914,405.88	0.54
52	JIANGXI COPPER CO LTD	江西铜业	CNE1000003K3	香港证券交易所	中国香港	88,500	1,902,517.87	0.53
53	GENERAL ELECTRIC CO	通用电器公司	US3696041033	纽约证券交易所	美国	15,500	1,891,842.87	0.53
54	UNITEDHEALTH GROUP INC	联合健康集团	US91324P1021	纽约证券交易所	美国	5,700	1,902,689.26	0.53
55	BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC	-	CA1125851040	多伦多证券交易所	加拿大	8,800	1,893,419.08	0.53

				易所				
56	SUEDZUCKER AG	-	DE0007297004	德国 证券交易所	德国	8,000	1,835,169.77	0.52
57	CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD	中国建材	CNE1000002N9	香港 证券交易所	中国 香港	142,000	1,802,054.01	0.51
58	MICROSOFT CORP	微软	US5949181045	纳斯 达克交 易所	美国	10,500	1,766,746.83	0.50
59	GREAT EAGLE HOLDINGS LTD	鹰君	BMG4069C1486	香港 证券交易所	中国 香港	81,000	1,741,287.55	0.49
60	VERIZON COMMUNICATIONS INC	威瑞森电 信公司	US92343V1044	纽约 证券交 易所	美国	7,300	1,758,845.01	0.49
61	UNY CO LTD	-	JP3949600005	东京 证券交 易所	日本	29,300	1,751,584.32	0.49
62	MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP	东京三菱 金融集团	JP3902900004	东京 证券交 易所	日本	54,200	1,696,176.53	0.48
63	COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO	碧桂园	KYG245241032	香港 证券交 易所	中国 香港	588,000	1,672,354.56	0.47
64	ATCO LTD	-	CA0467894006	多伦 多证 券交 易所	加拿 大	4,000	1,675,428.34	0.47
65	GEORGE WESTON LTD	-	CA9611485090	多伦 多证 券交 易所	加拿 大	3,600	1,688,194.53	0.47
66	VALEO SA	-	FR0000130338	巴黎 证券交 易所	法国	3,700	1,630,683.62	0.46
67	HAIER ELECTRONICS GROUP CO LTD	海尔电器	BMG423131256	香港 证券交 易所	中国 香港	206,000	1,654,890.55	0.46
68	LONKING HOLDINGS	中国龙工	KYG5636C1078	香港	中	459,000	1,622,282.74	0.46

	LTD			证券交易所	国香港			
69	BHP BILLITON LTD	必和必拓公司	AU000000BHP4	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	5,300	1,608,531.05	0.45
70	NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	澳大利亚国家银行	AU000000NAB4	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	8,900	1,579,969.12	0.44
71	AAC ACOUSTIC TECHNOLOGIES HOLDINGS	瑞声科技	KYG2953R1065	香港证券交易所	中国香港	104,000	1,567,171.26	0.44
72	HUTCHISON TELECOMMUNICATIONS HOLDINGS	和记电讯香港控股	KYG4672G1064	香港证券交易所	中国香港	788,000	1,572,759.75	0.44
73	US BANCORP	美国银行公司	US9029733048	纽约证券交易所	美国	9,400	1,551,850.88	0.44
74	SICHUAN EXPRESSWAY CO LTD	四川成渝	CNE100000494	香港证券交易所	中国香港	452,400	1,512,424.06	0.42
75	CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTER	招商局国际	HK0144000764	香港证券交易所	中国香港	60,000	1,499,410.88	0.42
76	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	三星电子	US7960508882	伦敦证券交易所	英国	600	1,505,035.32	0.42
77	JPMORGAN CHASE & CO	摩根大通银行	US46625H1005	纽约证券交易所	美国	5,700	1,510,199.66	0.42
78	DAH CHONG HONG HOLDINGS LTD	大昌行集团	HK1828040670	香港证券交易所	中国香港	190,000	1,466,312.40	0.41
79	AMERIPRISE FINANCIAL INC	Ameriprise 金融	US03076C1062	纽约证券交易所	美国	3,900	1,455,799.40	0.41
80	FORBO HOLDING AG	-	CH0003541510	瑞士	瑞	300	1,471,272.37	0.41

				证券交易所	士			
81	VOLKSWAGEN AG	福斯汽车	DE0007664039	德国证券交易所	德国	1,100	1,465,823.52	0.41
82	CHINA COMMUNICATIONS CONSTRUCT	中国交通建设股份	CNE1000002F5	香港证券交易所	中国香港	256,000	1,424,265.68	0.40
83	SINGAMAS CONTAINER HOLDINGS LTD	胜狮货柜	HK0716002271	香港证券交易所	中国香港	558,000	1,433,895.83	0.40
84	MICRON TECHNOLOGY INC	美光科技	US5951121038	纳斯达克交易所	美国	29,400	1,423,182.52	0.40
85	AGILE PROPERTY HOLDINGS LTD	雅居乐集团	KYG011981035	香港证券交易所	中国香港	138,000	1,384,048.54	0.39
86	KWG PROPERTY HOLDING LTD	合景泰富	KYG532241042	香港证券交易所	中国香港	320,500	1,380,647.22	0.39
87	TSMC	台积电	US8740391003	纽约证券交易所	美国	17,200	1,403,638.30	0.39
88	HARBIN POWER EQUIPMENT CO LTD	哈尔滨动力股份	CNE1000003C0	香港证券交易所	中国香港	181,000	1,336,646.20	0.38
89	ENN ENERGY HOLDINGS LTD	新奥能源	KYG3066L1014	香港证券交易所	中国香港	62,000	1,361,195.61	0.38
90	CONOCOPHILLIPS	康菲石油	US20825C1045	纽约证券交易所	美国	2,800	1,362,478.91	0.38
91	DISCOVER FINANCIAL SERVICES	-	US2547091080	纽约证券交易所	美国	7,800	1,350,299.36	0.38
92	ITOCHU CORP	伊藤忠商事	JP3143600009	东京证券交易所	日本	20,200	1,350,216.87	0.38

				所				
93	AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING	澳盛银行集团	AU000000ANZ3	澳大利亚证券交易所	澳大利亚	8,700	1,326,237.81	0.37
94	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	中国雨润食品	BMG211591018	香港证券交易所	中国香港	72,000	1,311,298.42	0.37
95	LIANHUA SUPERMARKET HOLDINGS CO	联华超市	CNE1000003P2	香港证券交易所	中国香港	86,400	1,278,965.03	0.36
96	XINYI GLASS HOLDINGS LTD	信义玻璃	KYG9828G1082	香港证券交易所	中国香港	200,000	1,282,358.03	0.36
97	SIMON PROPERTY GROUP INC	赛门物业集团	US8288061091	纽约证券交易所	美国	1,700	1,278,729.94	0.36
98	BILLERUD AB	-	SE0000862997	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	19,100	1,297,637.49	0.36
99	PRUDENTIAL PLC	保诚	GB0007099541	伦敦证券交易所	英国	16,400	1,227,866.72	0.35
100	CBS CORP	哥伦比亚广播公司	US1248572026	纽约证券交易所	美国	6,700	1,235,318.44	0.35
101	ATLAS COPCO AB	-	SE0000101032	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	7,300	1,246,439.58	0.35
102	XTEP INTERNATIONAL HOLDINGS	特步国际控股	KYG982771092	香港证券交易所	中国香港	278,000	1,222,997.02	0.34
103	RIO TINTO PLC	力拓矿业/英国	GB0007188757	伦敦证券交易所	英国	2,600	1,214,067.77	0.34
104	CIA DE BEBIDAS DAS AMERICAS	-	US20441W2035	纽约证券	美国	5,500	1,200,578.90	0.34

				交易所				
105	ZHAOJIN MINING INDUSTRY CO LTD	招金矿业 股份	CNE1000004R6	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	89,500	1,190,879.84	0.33
106	POST PROPERTIES INC	-	US7374641071	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,400	1,160,642.65	0.33
107	MELROSE PLC	-	GB00B23DKN29	伦 敦 证 券 交 易 所	英 国	30,700	1,155,638.03	0.32
108	AETNA INC	安泰金融 保险集团	US00817Y1082	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,000	1,141,331.38	0.32
109	VALERO ENERGY CORP	瓦勒罗能 源	US91913Y1001	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	6,800	1,125,255.94	0.32
110	ELPIDA MEMORY INC	尔必达	JP3167640006	东 京 证 券 交 易 所	日 本	15,000	1,131,426.31	0.32
111	CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	Capital One 金融	US14040H1059	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,300	1,103,479.00	0.31
112	LANXESS AG	朗盛公司	DE0005470405	德 国 证 券 交 易 所	德 国	2,100	1,112,672.26	0.31
113	SHANDONG CHENMING PAPER HOLDING	晨鸣纸业	CNE100000BK2	香 港 证 券 交 易 所	中 国 香 港	243,000	1,079,126.75	0.30
114	AMERICAN FINANCIAL GROUP INC/O	美国金融 集团	US0259321042	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	4,600	1,062,468.47	0.30
115	MCGRAW-HILL COS INC/THE	麦格罗希 尔	US5806451093	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	3,900	1,057,776.57	0.30
116	HESS CORP	-	US42809H1077	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	2,200	1,064,397.03	0.30

117	TYSON FOODS INC	泰森食品	US9024941034	纽约 证券 交易 所	美国	8,600	1,080,834.88	0.30
118	ALLIANZ SE	安联集团	DE0008404005	德国 证券 交易 所	德国	1,200	1,082,117.29	0.30
119	HUMANA INC	-	US4448591028	纽约 证券 交易 所	美国	2,000	1,042,445.34	0.29
120	CARDINAL HEALTH INC	-	US14149Y1082	纽约 证券 交易 所	美国	3,500	1,028,790.27	0.29
121	COMMUNITY BANK SYSTEM INC	-	US2036071064	纽约 证券 交易 所	美国	6,300	1,010,715.09	0.28
122	KONINKLIJKE DSM NV	-	NL0000009827	阿姆斯特丹 证券 交易 所	荷兰	2,300	963,609.17	0.27
123	MCKESSON CORP	麦卡逊	US58155Q1031	纽约 证券 交易 所	美国	1,800	974,428.84	0.27
124	KEYCORP	-	US4932671088	纽约 证券 交易 所	美国	18,100	975,742.56	0.27
125	PANAHOME CORP	-	JP3650600004	东京 证券 交易 所	日本	23,000	961,551.88	0.27
126	PROTECTIVE LIFE CORP	-	US7436741034	纽约 证券 交易 所	美国	6,200	928,066.30	0.26
127	PETROLEO BRASILEIRO SA	巴西石油 公司	US71654V1017	纽约 证券 交易 所	美国	4,400	873,614.26	0.25
128	TATA MOTORS LTD	塔塔汽车 有限公司	US8765685024	纽约 证券 交易 所	美国	6,200	903,189.46	0.25
129	PAR PHARMACEUTICAL	-	US69888P1066	纽约	美	4,100	875,076.83	0.25

	COS INC			证券交易所	国			
130	VOLVO AB	沃尔沃汽车	SE0000115446	斯德哥尔摩证券交易所	瑞典	7,900	895,207.07	0.25
131	RYOBI LTD	-	JP3975800008	东京证券交易所	日本	31,000	897,999.43	0.25
132	VMWARE INC	-	US9285634021	纽约证券交易所	美国	1,300	843,243.03	0.24
133	mitsubishi chemical holdings co	三菱化学控股	JP3897700005	东京证券交易所	日本	18,500	843,193.46	0.24
134	IHI CORP	IHI 公司	JP3134800006	东京证券交易所	日本	52,000	863,735.64	0.24
135	IMI PLC	-	GB0004579636	伦敦证券交易所	英国	7,500	821,229.45	0.23
136	EQUITY RESIDENTIAL	公平住屋信托	US29476L1070	纽约证券交易所	美国	2,100	815,421.61	0.23
137	NOVARTIS AG	诺华药厂	CH0012005267	瑞士证券交易所	瑞士	2,100	831,338.06	0.23
138	MITSUI & CO LTD	三井物产	JP3893600001	东京证券交易所	日本	7,400	821,816.72	0.23
139	CHINA QINF A GROUP LTD	中国秦发	KYG2159E1070	香港证券交易所	中国香港	244,000	767,019.76	0.22
140	INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC	-	GB0004564430	伦敦证券交易所	英国	23,800	798,639.53	0.22
141	AMERICA MOVIL SAB DE CV	-	US02364W1053	纽约证券	美国	2,200	767,117.59	0.22

				交易所				
142	EATON CORP	伊顿	US2780581029	纽约证券交易所	美国	2,400	799,113.19	0.22
143	IMPLENIA AG	-	CH0023868554	瑞士证券交易所	瑞士	3,700	782,141.92	0.22
144	SUMITOMO CORP	住友商事	JP3404600003	东京证券交易所	日本	8,800	768,984.72	0.22
145	DANIELI & C OFFICINE MECCANICH	达涅利钢铁设备制造集团	IT0000076502	意大利证券交易所	意大利	4,100	731,924.16	0.21
146	LENOVO GROUP LTD	联想集团	HK0992009065	香港证券交易所	中国香港	206,000	762,346.05	0.21
147	CHINA OVERSEAS GRAND OCEANS GP LTD	中国海外宏洋	HK0000065737	香港证券交易所	中国香港	88,000	743,534.81	0.21
148	ROSNEFT OIL CO	俄罗斯石油公司	US67812M2070	伦敦证券交易所	英国	13,400	730,177.70	0.21
149	HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH	杭庭顿银行	US4461501045	纳斯达克交易所	美国	17,600	747,185.06	0.21
150	MOTOROLA SOLUTIONS INC	摩托罗拉解决方案有限公司	US6200763075	纽约证券交易所	美国	2,500	744,881.17	0.21
151	LUKOIL OAO	卢克石油公司	US6778621044	伦敦证券交易所	英国	1,700	699,709.41	0.20
152	WELLS FARGO & CO	富国银行	US9497461015	纽约证券交易所	美国	4,000	726,372.40	0.20
153	PIER 1 IMPORTS INC	-	US7202791080	纽约证券交易所	美国	9,600	718,813.57	0.20

154	WUMART STORES INC	物美	CNE100000544	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	39,000	625,311.71	0.18
155	YINGDE GASES	盈德气体	KYG984301047	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	61,500	366,707.00	0.10
156	CITIC RESOURCES HOLDINGS LTD	中信资源	BMG2155Y1075	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	197,200	237,793.42	0.07
157	ZHONGPIN INC	众品公司	US98952K1079	纳 斯 达 克 交 易 所	美 国	2,000	135,644.74	0.04
158	SMARTONE TELECOMMUNICATIONS HOLDINGS	数码通 电 讯	BMG8219Z1059	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	300	2,889.05	0.00
159	CHINA OILFIELD SERVICES LTD	中海油 田 服 务	CNE1000002P4	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	600	7,065.44	0.00
160	GUANGZHOU SHIPYARD INTERNATION	广船国际	CNE100000395	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	1,000	10,860.96	0.00
161	CHINA SHIPPING CONTAINER LINES	中海集 装 箱 运 输	CNE100000536	香港 证券 交易 所	中 国 香 港	700	1,531.01	0.00

注：所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金 额	占期初基金资产净值比 例（%）
1	BANK OF CHINA LTD	CNE1000001Z5	12,992,674.28	2.37
2	BAIDU INC	US0567521085	9,167,416.36	1.67
3	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	8,331,948.02	1.52
4	CNOOC LTD	HK0883013259	8,193,822.91	1.49
5	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	CNE100000Q43	7,939,951.02	1.45
6	CHINA PETROLEUM &	CNE1000002Q2	7,680,084.70	1.40

	CHEMICAL CORP			
7	PETROCHINA CO LTD	CNE1000003W8	6,442,923.27	1.17
8	CHINA TELECOM CORP LTD	CNE1000002V2	6,045,865.26	1.10
9	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	KYG810431042	5,796,096.73	1.06
10	GREAT WALL MOTOR CO LTD	CNE100000338	5,591,232.06	1.02
11	CHINA SHENHUA ENERGY CO LTD	CNE1000002R0	5,588,618.40	1.02
12	TENCENT HOLDINGS LTD	KYG875721485	5,354,907.67	0.98
13	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	CNE1000002M1	4,987,423.57	0.91
14	CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP	CNE1000009Q7	4,620,666.43	0.84
15	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	KYG3774X1088	4,547,905.90	0.83
16	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	BMG211591018	4,298,923.74	0.78
17	ARKEMA SA	FR0010313833	4,176,540.42	0.76
18	CHINA SHANSHUI CEMENT GROUP LTD	KYG2116M1015	4,130,483.31	0.75
19	ROYAL DUTCH SHELL PLC	GB00B03MM408	3,961,939.86	0.72
20	CHINA SHIPPING CONTAINER LINES CO LTD	CNE100000536	3,904,799.64	0.71

注：1、买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2% 或前 20 名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	CNOOC LTD	HK0883013259	16,943,905.39	3.09
2	CHINA MOBILE LTD	HK0941009539	15,727,909.22	2.87
3	BANK OF CHINA LTD	CNE1000001Z5	14,679,878.58	2.68
4	TENCENT	KYG875721485	10,283,424.69	1.87

	HOLDINGS LTD			
5	CHINA LIFE INSURANCE CO LTD	CNE1000002L3	9,253,495.77	1.69
6	CHINA OILFIELD SERVICES LTD	CNE1000002P4	8,456,023.30	1.54
7	AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD	CNE100000Q43	8,383,502.73	1.53
8	BAIDU INC	US0567521085	7,303,795.04	1.33
9	PETROCHINA CO LTD	CNE1000003W8	7,096,210.96	1.29
10	CHINA PETROLEUM & CHEMICAL CORP	CNE1000002Q2	6,735,769.90	1.23
11	GCL POLY ENERGY HOLDINGS LTD	KYG3774X1088	6,153,418.42	1.12
12	CHINA YURUN FOOD GROUP LTD	BMG211591018	6,079,900.54	1.11
13	PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD	CNE1000003X6	5,833,229.91	1.06
14	SHIMAO PROPERTY HOLDINGS LTD	KYG810431042	5,224,259.62	0.95
15	AAC ACOUSTIC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC	KYG2953L1095	4,876,834.65	0.89
16	CHINA MERCHANTS BANK CO LTD	CNE1000002M1	4,629,902.95	0.84
17	YANZHOU COAL MINING CO LTD	CNE1000004Q8	4,516,536.99	0.82
18	ANTA SPORTS PRODUCTS LTD	KYG040111059	4,451,192.90	0.81
19	SINOPEC YIZHENG CHEMICAL FIBRE CO LTD	CNE1000004D6	4,388,332.39	0.80
20	SICHUAN EXPRESSWAY CO LTD	CNE100000494	4,293,720.05	0.78

注：1、卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)，不包括相关交易费用。

2、所用证券代码采用 ISIN 代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	499,989,421.04
------------	----------------

卖出收入（成交）总额	655,462,450.45
------------	----------------

注：买入股票成本总额和卖出股票收入总额均为买卖成交金额（成交单价乘以成交数量），不包括相关交易费用。

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品投资。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期末出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	774,223.00
3	应收股利	1,645,348.57
4	应收利息	48,292.22
5	应收申购款	12,835.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	1,024,445.30
9	合计	3,505,144.84

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的 基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
15,990	22,737.52	4,798,189.44	1.32%	358,774,814.34	98.68%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	4,926.16	0.00%

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010年9月14日）基金 份额总额	681,944,805.65
本报告期期初基金份额总额	557,627,789.53
本报告期基金总申购份额	1,452,260.98
减：本报告期基金总赎回份额	195,507,046.73
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	363,573,003.78

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人未发生重大的人事变动。

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金基金管理人、基金财产以及基金托管人基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

自本基金基金合同生效日起普华永道中天会计师事务所为本基金提供审计服务至今，本报告期内会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事和高级管理人员被中国证监会、证券业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

本报告期内，本基金托管人涉及托管业务的高级管理人员未受到监管部门的稽查和处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
MERRILL LYNCH	-	270,204,102.67	23.39%	186,736.55	18.83%	-
UBS	-	199,595,331.09	17.27%	133,173.98	13.43%	-
CREDIT LYONNAIS	-	159,831,244.88	13.83%	139,448.09	14.06%	-
MORGAN STANLEY	-	121,601,002.67	10.52%	84,886.03	8.56%	-
CITIGROUP	-	73,925,355.95	6.40%	50,355.73	5.08%	-
MACQUARIE	-	65,906,153.87	5.70%	51,959.12	5.24%	-
DEUTSCHE BANK	-	59,607,769.26	5.16%	71,431.77	7.20%	-
CREDIT SUISSE	-	39,340,909.81	3.40%	34,188.12	3.45%	-
ITG	-	34,004,041.25	2.94%	34,612.78	3.49%	-
INSTINET	-	29,985,253.07	2.60%	25,935.39	2.62%	-
J.P. MORGAN	-	25,619,794.10	2.22%	65,147.73	6.57%	-
NOMURA	-	15,853,605.62	1.37%	26,251.92	2.65%	-
BARCLAYS	-	10,550,248.18	0.91%	8,429.22	0.85%	-
SCOTIA	-	8,406,486.95	0.73%	13,806.45	1.39%	-
ABN AMRO	-	6,577,777.33	0.57%	13,155.56	1.33%	-
GOLDMAN SACHS	-	6,262,104.35	0.54%	11,646.75	1.17%	-
MIZUHO	-	4,732,370.32	0.41%	7,098.34	0.72%	-
ROYAL BANK OF CANADA	-	4,639,155.66	0.40%	2,026.28	0.20%	-
BANK OF NEW YORK	-	4,167,590.79	0.36%	3,459.24	0.35%	-
STIFEL NICOLAUS	-	2,678,913.00	0.23%	446.67	0.05%	-
DAIWA	-	2,271,856.79	0.20%	15,032.58	1.52%	-
NBF SECURITIES CORP	-	2,067,709.50	0.18%	1,596.79	0.16%	-

CARNEGIE	-	1,840,751.41	0.16%	2,761.12	0.28%	-
WILLIAM BLAIR	-	1,834,257.78	0.16%	1,508.58	0.15%	-
STANDARD CHARTERED	-	1,361,191.47	0.12%	2,722.38	0.27%	-
FIDELITY	-	917,369.62	0.08%	1,283.81	0.13%	-
CIBC WORLD MARKETS	-	630,879.46	0.05%	2,142.11	0.22%	-
T D NEWCREST	-	422,050.76	0.04%	178.43	0.02%	-
LIQUIDNET	-	411,643.67	0.04%	169.09	0.02%	-
PIPER JAFFRAY CO	-	97,842.00	0.01%	-	-	-
PACIFIC CREST SECURITIES	-	48,921.00	0.00%	-	-	-
ROYAL BANK OF SCOTLAND	-	41,871.66	0.00%	62.84	0.01%	-
BLAYLOCK ROBERT VAN	-	16,315.55	0.00%	11.41	0.00%	-
CANTOR FITZGERALD AND CO., INC.	-	-	-	-	-	-
HSBC	-	-	-	-	-	-
ICHIYOSHI	-	-	-	-	-	-
MITSUBISHI SECURITIES	-	-	-	-	-	-
RBC CAPITAL MARKETS -ALGO	-	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金管理人制定了服务券商的选择标准，具体如下：

(1) 交易执行能力：能够公平对待所有客户，实现最佳价格成交，可靠、诚信、及时成交，具备充分流动性，交易差错少等；

(2) 研究支持服务：能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务，包括举办推介会、拜访公司、及时沟通市场情况、承接专项研究、协助交易评价等；

(3) 财务实力：净资产、总市值、受托资产等指标处于行业前列，或具有明显的安全边际；

(4) 后台便利性和可靠性：交易和清算支持多种方案，软件再开发的能力强，系统稳定安全等；

(5) 组织框架和业务构成：具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(6) 其他有利于基金份额持有人利益的商业合作考虑。

海外投资部在根据以上标准进行评估后并结合海外投资顾问提供的建议，列出券商名单

报海外投资决策委员会最终确定。

2、券商的服务评价

(1) 海外投资部每半年组织“服务总结”及评分。

(2) 若券商提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，经海外投资决策委员会批准，公司将提前终止租用其交易席位。

3、本报告期本基金新增 BLAYLOCK ROBERT VAN、CARNEGIE、CIBC WORLD MARKETS、LIQUIDNET、NOMURA、PACIFIC CREST SECURITIES、ROYAL BANK OF CANADA、ROYAL BANK OF SCOTLAND、STANDARD CHARTERED、STIFEL NICOLAUS、TD NEWCREST、WILLIAM BLAIR 作为本基金的服务券商，本报告期无剔除的服务券商。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
MERRILL LYNCH	-	-	-	-	-	-	55,375,214.72	25.28%
UBS	-	-	-	-	-	-	58,223,289.13	26.58%
CREDIT LYONNAIS	-	-	-	-	-	-	17,804,115.39	8.13%
MORGAN STANLEY	-	-	-	-	-	-	5,533,428.87	2.53%
CITIGROUP	-	-	-	-	-	-	3,636,420.11	1.66%
MACQUARIE	-	-	-	-	-	-	1,092,682.15	0.50%
DEUTSCHE BANK	-	-	-	-	-	-	14,487,469.63	6.61%
CREDIT SUISSE	-	-	-	-	-	-	12,362,153.40	5.64%
J.P. MORGAN	-	-	-	-	-	-	38,386,971.46	17.52%
BANK OF NEW YORK	-	-	-	-	-	-	2,858,250.98	1.30%
DAIWA	-	-	-	-	-	-	5,244,432.62	2.39%
FIDELITY	-	-	-	-	-	-	4,061,180.59	1.85%

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于开通建设银行借记卡基金网上交易	指定报刊和/或公司	2011-06-28

	业务并实施费率优惠的公告	网站	
2	关于旗下部分开放式基金参加交通银行网上银行及手机银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-28
3	关于旗下部分开放式基金通过中国工商银行开办基金定投业务暨参加基金定投优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-16
4	建信基金管理有限责任公司关于公司股权变更等相关事项的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-06-09
5	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-28
6	关于旗下开放式基金通过中信证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-05-05
7	建信基金管理有限责任公司关于增聘建信全球机遇股票型证券投资基金基金经理的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-04-22
8	关于新增民生证券为旗下部分开放式基金代销机构的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-04-21
9	关于参加中国工商银行个人电子银行基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-30
10	关于旗下部分开放式基金参加海通证券网上交易系统基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-29
11	关于通过海通证券开办旗下部分开放式基金定投业务暨参加海通证券定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-29
12	建信基金管理有限责任公司关于旗下基金持有的双汇发展估值方法变更的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-23
13	关于通过中信建投证券开办旗下部分开放式基金定投业务暨参加中信建投证券定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-17
14	关于旗下部分开放式基金参加中信建投证券网上交易系统基金申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-17
15	关于建信基金管理有限责任公司与中国建设银行股份有限公司之间发生的关联交易的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-09
16	关于旗下部分开放式基金参加光大证券网上交易系统定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-07
17	关于旗下部分开放式基金通过光大证券开办基金定投业务的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-03-07
18	关于通过建设银行开办旗下部分开放式基金定投业务暨参加建设银行定投申购费率优惠活动的公告	指定报刊和/或公司网站	2011-02-18

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准建信全球机遇股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、《建信全球机遇股票型证券投资基金基金合同》；
- 3、《建信全球机遇股票型证券投资基金招募说明书》；
- 4、《建信全球机遇股票型证券投资基金托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告。

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

建信基金管理有限责任公司

二〇一一年八月二十四日